

令和 4年9月7日

各 位

外国投資法人名	ウィズダムツリー・コモディティ・セキュリティーズ・リミテッド
代表者	クリストファー・フォールズ
管理会社名	ウィズダムツリー・マネジメント・ジャージー・リミテッド
(管理会社コード 16724)	
代表者	スティーブン・ロス
問合せ先	TMI総合法律事務所
担当者	中川秀宣
(TEL 03-6438-5660)	

上場ETF(管理会社:WisdomTree、外国投資法人:CSL)に関する日々の開示事項

ウィズダムツリー・マネジメント・ジャージー・リミテッド(WisdomTree)を管理会社に、
ウィズダムツリー・コモディティ・セキュリティーズ・リミテッド(CSL)を外国投資法人として上場する
以下のETF銘柄について、令和 4年9月6日現在の状況をご報告します。

上場ETF 銘柄(14銘柄)

掲載番号	銘柄名	銘柄コード	上場取引所
1	WisdomTree プロード上場投資信託(商品ETF)	1684	東
2	WisdomTree エネルギー上場投資信託(エナジーETF)	1685	東
3	WisdomTree 産業用金属上場投資信託(メタルETF)	1686	東
4	WisdomTree 農産物上場投資信託(アグリETF)	1687	東
5	WisdomTree 穀物上場投資信託(穀物ETF)	1688	東
6	WisdomTree 天然ガス上場投資信託(ガスETF)	1689	東
7	WisdomTree WTI原油上場投資信託(原油ETF)	1690	東
8	WisdomTree ガソリン上場投資信託(ガソリンETF)	1691	東
9	WisdomTree アルミニウム上場投資信託(アルミETF)	1692	東
10	WisdomTree 銅上場投資信託(銅ETF)	1693	東
11	WisdomTree ニッケル上場投資信託(ニッケルETF)	1694	東
12	WisdomTree 小麦上場投資信託(小麦ETF)	1695	東
13	WisdomTree とうもろこし上場投資信託(コーンETF)	1696	東
14	WisdomTree 大豆上場投資信託(大豆ETF)	1697	東

* 各銘柄の状況につきましては、次のページ以降をご参照ください。なお、各銘柄名をクリックしていただくと、各銘柄の状況が表示されます。

以 上

[掲載番号1]

令和4年9月7日

各 位

外国投資法人名 代表者	ウイズダムツリー・コモディティ・セキュリティーズ・リミテッド クリストファー・フォールズ
管理会社名 (銘柄コード 1684) 代表者	ウイズダムツリー・マネジメント・ジャージー・リミテッド スティーブン・ロス
問合せ先 担当者	TMI総合法律事務所 中川秀宣 (TEL 03-6438-5660)

WisdomTree ブロード上場投資信託(商品ETF)に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの口数(令和4年9月7日午前0時(ロンドン時間2022年9月6日午後4時)現在)

12,312,432 口

2. 上場ETFの資産総額(令和4年9月7日午前0時(ロンドン時間2022年9月6日午後4時)現在)

(上場ETFの資産総額は、上場ETFの口数に上場ETFの一口あたりの資産額を乗じて計算しています。日本円への換算は、令和4年9月7日午前6時(ニューヨーク時間2022年9月6日午後5時)現在のブルームバーグによる為替レート(1米ドル=142.79円)により計算しています。)

21,207,315,507 円 (148,521,013.42 米ドル)

3. 上場ETFの一口あたりの資産額(令和4年9月7日午前0時(ロンドン時間2022年9月6日午後4時)現在)

(上場ETF一口当たりの資産額は、ロンドンの当日午後4時にロンドン証券取引所での取引が終了した後、指数が追随する米国先物市場終了後に確定される指標の値を用いて、ロンドン時間同日午後4時現在のものとして計算されています。日本円への換算は、令和4年9月7日午前6時(ニューヨーク時間2022年9月6日午後5時)現在のブルームバーグによる為替レート(1米ドル=142.79円)により計算しています。)

1,722 円 (12.06 米ドル)4. 上場ETFの一口あたりの資産額の日々の価格の変動幅と特定の指標の終値の日々の変動幅の乖離率
(令和4年9月7日午前0時(ロンドン時間2022年9月6日午後4時)現在)0.06%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの} - \text{特定の指標の}}{\text{一口あたりの資産額} - \text{終値}} \right) \times 100 (\%)$$

$$\left(\frac{\text{前営業日の上場ETF} - \text{前営業日の}}{\text{一口あたりの資産額} - \text{特定の指標の終値}} \right) \times 100 (\%)$$

5. ロールオーバー時の損益について

各々の単一商品指標は、特定の満期の先物契約から値付けされますが、当該先物契約は、満期が近付くと、期先の先物契約に「乗り換える」必要が生じ、このプロセスは「乗換え(rolling)」と呼ばれます。单一商品指標構成する取引所上場先物契約は、その満期が近付くと、満期前に期先の満期の同様の先物契約に入れ替えられます。従って、例えば、8月に買い付けられ、保有されている先物契約が10月に満期となる場合があります。

時間が経過するにつれ、10月に満期を迎える先物契約は、11月限の先物契約に入れ替えられることになります。もともと期近の先物契約とともに期先の先物契約との差額は、「乗換えに伴う収益(roll yield)」と呼ばれ、これは利益となることもあります。この先物契約にかかる市場が(その他の要因は考慮しないものとします。)「逆戻(バックワードィジョン: backwardation)」(期先の満期の先物契約の価格の方が期近の満期の先物契約の価格に比べて低いことを意味します。)である場合には、10月限先物契約の売却が、11月限先物契約よりも高い価格で行われ、「乗換えに伴う収益」が発生します。商品指標に含まれている先物契約の中には、過去に逆戻の期間が持続することを示しているものもある一方で、逆戻は常に存在している訳ではありません。

更に、商品指標に反映されている一定の商品には、過去に、「順轉(コンタング: contango)」市場で取引されてきたものもあります。順轉市場とは、先物契約の価格が期近限月のものよりも、期先限月のものの方が高くなっている市場のことです。特定の商品市場において逆戻が存在しないことの結果として、「乗換えに伴う収益」がマイナスとなります。このため、商品指標及び単一商品指標の価値に悪影響が及び、その結果として、マイクロ上場投資信託、單一マイクロ上場投資信託、商品上場投資信託及び商品指標上場投資信託の価値が下落するおそれがあります。更に、これにより、商品指標における期近先物契約及び次期近先物契約はブルームバーグ商品3ヶ月先物指標において用いられているものは異なるため、先物曲線の関連する部分が異なる量の逆戻又は順轉を示している場合、両指標に異なる形で影響を及ぼす逆戻及び(又は順轉がもたらされる可能性があります)しかし、特定の商品市場において順轉(又は逆戻)が存在することによって、自動的に「乗換えに伴う収益」がマイナスとなる(又はプラスとなる)ということではありません。潜在的な乗換えに伴う収益が実際に実現するかどうかは、先物曲線の形状に依存しています。「先物曲線」とは、異なる満期を有する先物契約に關し、先物契約の価格間の相関関係をグラフで表したものであります。商品先物曲線の関連する部分が逆戻となっている(右下がりの先物曲線となっている)場合には、その他の要因が全て同じであるとすれば、相対的に低くなっている先物価格が相対的に高くなっているスポット価格に収束していくに従って、関連する指標は上昇する傾向があります。順轉の場合には、反対の結果が生じます。

以 上

[掲載番号2]

令和 4年 9月 7日

各 位

外国投資法人名 ウィズダムツリー・コモディティ・セキュリティーズ・リミテッド
代表者 クリストファー・フォールズ
管理会社名 ウィズダムツリー・マネジメント・ジャージー・リミテッド
(銘柄コード 1685)
代表者 スティーブン・ロス
問合せ先 TMI総合法律事務所
担当者 中川秀宣
(TEL 03-6438-5660)

WisdomTree エネルギー上場投資信託(エナジーETF)に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの日数(令和4年9月7日午前0時(ロンドン時間2022年9月6日午後4時)現在)

23.117.132 日

2. 上場ETFの資産総額（令和4年9月7日午前0時（ロンドン時間2022年9月6日午後4時）現在）
(上場ETFの資産総額は、上場ETFの口数に上場ETFの一口あたりの資産額を乗じて計算しています。日本円への換算は、令和4年9月7日午前6時（ニューヨーク時間2022年9月6日午後5時）現在のブルームバーグによる為替レート（1米ドル=142.79円）により計算しています。)

17,961,494,868 円 (125,789,585.18 米ドル)

3. 上場ETFの一口あたりの資産額（令和4年9月7日午前0時（ロンドン時間2022年9月6日午後4時）現在）
（上場ETF一口当たりの資産額は、ロンドンの当日午後4時にロンドン証券取引所での取引が終了した後、指数
が追随する米国先物市場終了後に確定される指標の値を用いて、ロンドン時間同日午後4時現在のものとして
計算されています。日本円への換算は、令和4年9月7日午前6時（ニューヨーク時間2022年9月6日午後5時）
現在のブルームバーグによる為替レート（1米ドル＝142.79円）により計算しています。）

777 円 (5.44 米ドル)

4. 上場ETFの一口あたりの資産額の日々の価格の変動幅と特定の指標の終値の日々の変動幅の乖離率(令和4年9月7日午前0時(ロンドン時間2022年9月6日午後4時)現在)

0.33%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの} - \text{特定の指標の}}{\text{一口あたりの資産額} - \text{終値}} \times 100 (\%) \right)$$

前営業日の上場ETFの
一口あたりの資産額

前営業日の
特定の指標の終値

5. ロールオーバー時の損益について

各々の単一商品指数は、特定の満期の先物契約から値付けされますが、当該先物契約は、満期が近付くと、期先の先物契約に「乗り換える」必要が生じ、このプロセスを「乗換(rolling)」と呼ばれます。单一商品指標を構成する取引所上場先物契約は、その満期が近付くと、満期前に期先の満期の同様の先物契約に入れ替えられます。従って、例えば、8月に買付けられ保有されている先物契約が10月に満期となる場合があります。

時間帯が経過するにつれ、10月に満期を迎える先物契約は、11月限の先物契約に入れ替わられることになります。もっとも期近の先物契約とともに期先の先物契約との差額は、「買換えに牛両収益(roll yield)」と呼ばれ、これは利益となることもあります。この先物契約にかかる市場がその他の要因を考慮しないものとします。(逆操作(バックワード・インボン:backwardation):「期先の満期の先物契約の価格の方が期近の満期の先物契約の価格に比べて低いことを意味します)。では場合には、10月限先物契約の売却が、11月限先物契約よりも高い価格で行われ、「買換えに牛両収益」が発生します。商品指数に含まれている先物契約の中には、過去に逆戻しの期間が付与されることで、逆戻しの牛両を手に入れることがあります。

先物契約の中には、過去に逆説の期間が持続することをしているものもある一方で、逆説は常に存在している訳ではありません。

更に、商品指数に反映されている一定の商品には、過去に、「順航(コンタゴ:contango)」市場で取引されたことがあります。順航市場とは、先物契約の価格が期近限月のものよりも、期先限月のものが高くなっている市場のことです。特定の商品市場において逆説が存在しないことの結果として、「乗換えに伴う収益」がマイナスとなります。そのため、商品指数及び単一商品指数の価値に悪影響が及び、その結果として、マイクロ上場投資信託、單一マイクロ上場投資信託、商品上場投資信託及び商品指数上場投資信託の価値が下落するおそれがあります。更に、これにより、商品指数における期先物契約及び期次先物契約はフルームーバージ商品3ヶ月先物指数において用いられているものは異なるため、先物曲線の関連する部分が異なる量の逆説又は順航を示している場合、両指數に異なる形態で影響を及ぼす逆説又は順航がもたらされる可能性があります。しかし、特定の商品市場において順航(又は逆説)が存在することによって、自動的に「乗換に伴う収益」がマイナスとなる(又はプラスとなる)ということではありません。潜在的な乗換に伴う収益が実際に実現するかどうかは、先物曲線の形状に依存しています。「先物曲線」とは、異なる満期を有する先物契約に関し、先物契約の価格間の相関関係をグラフで表したものです。商品先物曲線の関連する部分が逆説になっている(右下がりの先物曲線と呼ばれている)場合には、その他の要因が全て同じであるとすれば、相対的に低くなっている先物價格が相対的に高いになっているスワロット価格に収束していく傾向に従事する傾向があります。順航の場合には、反対の結果が生じます。

三

[掲載番号3]

令和4年9月7日

各 位

外国投資法人名 代表者	ウイズダムツリー・コモディティ・セキュリティーズ・リミテッド クリストファー・フォールズ
管理会社名 (銘柄コード 1686) 代表者	ウイズダムツリー・マネジメント・ジャージー・リミテッド スティーブン・ロス
問合せ先 担当者	TMI総合法律事務所 中川秀宣 (TEL 03-6438-5660)

WisdomTree 産業用金属上場投資信託(メタルETF)に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの口数(令和4年9月7日午前0時(ロンドン時間2022年9月6日午後4時)現在)

37,921,802 口

2. 上場ETFの資産総額(令和4年9月7日午前0時(ロンドン時間2022年9月6日午後4時)現在)

(上場ETFの資産総額は、上場ETFの口数に上場ETFの一口あたりの資産額を乗じて計算しています。日本円への換算は、令和4年9月7日午前6時(ニューヨーク時間2022年9月6日午後5時)現在のブルームバーグによる為替レート(1米ドル=142.79円)により計算しています。)

78,126,400,934 円 (547,141,963.26 米ドル)

3. 上場ETFの一口あたりの資産額(令和4年9月7日午前0時(ロンドン時間2022年9月6日午後4時)現在)

(上場ETF一口当たりの資産額は、ロンドンの当日午後4時にロンドン証券取引所での取引が終了した後、指数が追随する米国先物市場終了後に確定される指標の値を用いて、ロンドン時間同日午後4時現在のものとして計算されています。日本円への換算は、令和4年9月7日午前6時(ニューヨーク時間2022年9月6日午後5時)現在のブルームバーグによる為替レート(1米ドル=142.79円)により計算しています。)

2,060 円 (14.43 米ドル)4. 上場ETFの一口あたりの資産額の日々の価格の変動幅と特定の指標の終値の日々の変動幅の乖離率
(令和4年9月7日午前0時(ロンドン時間2022年9月6日午後4時)現在)0.01%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left[\frac{\text{上場ETFの} - \text{特定の指標の}}{\text{一口あたりの資産額} - \text{終値}} \right] \times 100 (\%)$$

$$\frac{\text{前営業日の上場ETF} - \text{前営業日の}}{\text{一口あたりの資産額} - \text{特定の指標の終値}}$$

5. ロールオーバー時の損益について

各々の単一商品指数は、特定の満期の先物契約から償付けされますが、当該先物契約は、満期が近付くと、期先の先物契約に「乗り換える」必要が生じ、このプロセスは「乗換え(rolling)」と呼ばれます。単一商品指数を構成する取引所上場先物契約は、その満期が近付くと、満期前に期先の満期の同様の先物契約に入れ替えられます。従って、例えば、8月に買い付けられ、保有されている先物契約が10月に満期となる場合があります。

時間が経過するにつれ、10月に満期を迎える先物契約は、11月限の先物契約に入れ替えられることになります。もっとも期近の先物契約とともに期先の先物契約との差額は、「乗換えに伴う収益(roll yield)」と呼ばれ、これは利益となることもあります。この先物契約にかかる市場が(その他の要因は考慮しないものとします)、「逆輸送(ハンクワードエインジョン:backwardation)」(期先の満期の先物契約の方が期近の満期の先物契約の価格に比べて低いことを意味します)である場合には、10月限先物契約の売却が、11月限先物契約よりも高い価格で行われ、「乗換えに伴う収益」が発生します。商品指標に含まれている先物契約の中には、過去に逆輸送の期間が持続することを示しているものもある一方で、逆輸送は常に存在している訳ではありません。

更に、商品指標に反映されている一定の商品には、過去に、「順輸送(contango)」市場で取引されてきたものもあります。順輸送市場とは、先物契約の価格が期近限月のものよりも、期先限月のものの方が高くなっている市場のことです。特定の商品市場において逆輸送が存在しないことの結果として、「乗換えに伴う収益」がマイナスとなります。このため、商品指標及び単一商品指標の価値に悪影響が及び、その結果として、マイクロ上場投資信託、商品上場投資信託及び商品指標上場投資信託の価値が下落するおそれがあります。更に、これにより、商品指標における期近先物契約及び次期近先物契約はブルームバーグ商品3ヶ月先物指標において用いられているものは異なるため、先物曲線の関連する部分が異なる量の逆輸送又は順輸送を示している場合、両指標に異なる形で影響を及ぼす逆輸送及び/又は順輸送がもたらされる可能性があります。しかし、特定の商品市場において順輸送(又は逆輸送)が存在することによって、自動的に「乗換えに伴う収益」がマイナスとなる(又はプラスとなる)ということではありません。潜在的な乗換えに伴う収益が実際に実現するかどうかは、先物曲線の形状に依存しています。「先物曲線」とは、異なる満期を有する先物契約に関し、先物契約の価格間の相関関係をグラフで表したものをおいいます。商品先物曲線の関連する部分が逆輸送となっている(右下がりの先物曲線となっている)場合には、その他の要因が全て同じであるとすれば、相対的に低くなっている先物価格が相対的に高くなっているスポット価格に収束していくに従って、関連する指標は上昇する傾向があります。順輸送の場合には、反対の結果が生じます。

以 上

[掲載番号4]

令和 4年 9月 7日

各 位

外国投資法人名 ウィズダムツリー・コモディティ・セキュリティーズ・リミテッド
代表者 クリストファー・フォールズ
管理会社名 ウィズダムツリー・マネジメント・ジャージー・リミテッド
(銘柄コード 1687)
代表者 スティーブン・ロス
問合せ先 TMI総合法律事務所
担当者 中川秀宣
(TEL 03-6438-5660)

WisdomTree 農産物上場投資信託(アグリETF)に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの口数(令和4年9月7日午前0時(ロンドン時間2022年9月6日午後4時)現在)

49,377,812 □

2. 上場ETFの資産総額（令和4年9月7日午前0時（ロンドン時間2022年9月6日午後4時）現在）
(上場ETFの資産総額は、上場ETFの口数に上場ETFの一口あたりの資産額を乗じて計算しています。日本円への換算は、令和4年9月7日午前6時（ニューヨーク時間2022年9月6日午後5時）現在のブルームバーグによる為替レート（1米ドル=142.79円）により計算しています。)

46,351,890,742 円 (324,615,804.62 米ドル)

3. 上場ETFの一口あたりの資産額（令和4年9月7日午前0時（ロンドン時間2022年9月6日午後4時）現在）
（上場ETF一口当たりの資産額は、ロンドンの当日午後4時にロンドン証券取引所での取引が終了した後、指数
が追随する米国先物市場終了後に確定される指標の値を用いて、ロンドン時間同日午後4時現在のものとして
計算されています。日本円への換算は、令和4年9月7日午前6時（ニューヨーク時間2022年9月6日午後5時）
現在のブルームバーグによる為替レート（1米ドル＝142.79円）により計算しています。）

939 円 (6.57 米ドル)

4. 上場ETFの一口あたりの資産額の日々の価格の変動幅と特定の指標の終値の日々の変動幅の乖離率(令和4年9月7日午前0時(ロンドン時間2022年9月6日午後4時)現在)

-0.03%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの資産額}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの資産額}} - \frac{\text{特定の指標の終値}}{\text{前営業日の特定の指標の終値}} \right) \times 100 (\%)$$

- ## 5. ロールオーバー時の損益について

各々の単一商品指数は、特定の満期の先物契約から値付けされますが、当該先物契約は、満期が近くと、期先の先物契約に「乗り換える」必要が生じ、このつのローリング(rolling)と呼ばれます。單一商品指構成する取引所上場先物契約は、その満期が近くと、満期前に期先の満期の同様の先物契約に入れ替えられます。従って、例えば、8月に買付けられ、保有されている先物契約が10月に満期となる場合があります。

時間が経過するにつれ、10月に満期を迎える先物契約は、11月限の先物契約に入れ替えられることになります。もともと期近の先物契約とともに期先の先物契約の差額は、**「現物搬入に伴う収益(roll yield)」**と呼ばれ、これは利益となることはあれば損失となることもあります。この先物契約にかかる市場が「その他の要因」考慮しないものとします。**「現貨(バックスケーリング/backwardation)」**期先の満期の先物契約の価格の方が期近の満期の先物契約の価格に比べて低いことを意味します。である場合には、10月限先物契約の売却が、11月限先物契約よりも高い価格で行われ、「現物搬入に伴う収益」が発生します。商品指数に含まれている先物契約の中でも、**「渋水に逆船の掛け持つることを云ふ」**といいますのはさりげなく生まれます。

る先物契約の中には、過去に逆説の期間が持続することをしているものもある一方で、逆説は常に存在している試ではあります。順説市場とは、先物契約の価格が期近限月のものよりも、期先限月のものの方が高くなっている市場のことです。特定の商品市場において逆説が存在しないことの結果として、「乗換えに伴う収益」がマイナスとなります。そのため、商品指標及び単一商品指標の価値に悪影響が及び、その結果として、マイクロ上場投資信託、單一マイクロ上場投資信託、商品上場投資信託及び商品指標上場投資信託の価値が下落するおそれがあります。更に、これにより、商品指標における期先物契約及び期次先物契約はフルームーバージ商品3ヶ月先物指標において用いられているものとは異なるため、先物曲線の関連する部分が異なる量の逆説又は順説を示している場合、両指標に異なる形で影響を及ぼす逆説及び又は順説がもたらされる可能性があります。しかし、特定の商品市場において順説(又は逆説)が存在することによって、自動的に「乗換えに伴う収益」がマイナスとなる(又はプラスとなる)ということではありません。潜在的な乗換えに伴う収益が実際に実現するかどうかは、先物曲線の形状に依存しています。「先物曲線」とは、異なる満期を有する先物契約に關し、先物契約の価格間の相間関係をグラフで表したものです。商品先物曲線の関連する部分が逆説になっている(右下方)の先物曲線とならない)場合には、その他の要因が全て同じであるとすれば、相対的に低くなっている先物價格が相対的に高くなっているスパントル価格に収束していく傾向に従事して、順説の場合は、反対の結果が牛になります。

三

[掲載番号5]

令和4年9月7日

各 位

外国投資法人名 代表者	ウイズダムツリー・コモディティ・セキュリティーズ・リミテッド クリストファー・フォールズ
管理会社名 (銘柄コード 1688) 代表者	ウイズダムツリー・マネジメント・ジャージー・リミテッド スティーブン・ロス
問合せ先 担当者	TMI総合法律事務所 中川秀宣 (TEL 03-6438-5660)

WisdomTree 穀物上場投資信託(穀物ETF)に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの口数(令和4年9月7日午前0時(ロンドン時間2022年9月6日午後4時)現在)

7,099,606 口

2. 上場ETFの資産総額(令和4年9月7日午前0時(ロンドン時間2022年9月6日午後4時)現在)

(上場ETFの資産総額は、上場ETFの口数に上場ETFの一口あたりの資産額を乗じて計算しています。日本円への換算は、令和4年9月7日午前6時(ニューヨーク時間2022年9月6日午後5時)現在のブルームバーグによる為替レート(1米ドル=142.79円)により計算しています。)

4,867,677,940 円 (34,089,767.77 米ドル)

3. 上場ETFの一口あたりの資産額(令和4年9月7日午前0時(ロンドン時間2022年9月6日午後4時)現在)

(上場ETF一口当たりの資産額は、ロンドンの当日午後4時にロンドン証券取引所での取引が終了した後、指数が追隨する米国先物市場終了後に確定される指標の値を用いて、ロンドン時間同日午後4時現在のものとして計算されています。日本円への換算は、令和4年9月7日午前6時(ニューヨーク時間2022年9月6日午後5時)現在のブルームバーグによる為替レート(1米ドル=142.79円)により計算しています。)

686 円 (4.80 米ドル)

4. 上場ETFの一口あたりの資産額の日々の価格の変動幅と特定の指標の終値の日々の変動幅の乖離率(令和4年9月7日午前0時(ロンドン時間2022年9月6日午後4時)現在)

-0.04%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left\{ \frac{\text{上場ETFの} \quad \text{特定の指標の} \\ \text{一口あたりの資産額} \quad \text{終値}}{\text{前営業日の上場ETFの} \quad \text{前営業日の} \\ \text{一口あたりの資産額} \quad \text{特定の指標の終値}} - \right\} \times 100 (\%)$$

5. ロールオーバー時の損益について

各々の単一商品指數は、特定の満期の先物契約から償付けされますが、当該先物契約は、満期が近付くと、期先の先物契約に「乗り換える」必要が生じ、このプロセスは「乗換え(rolling)」と呼ばれます。単一商品指數を構成する取引所上場先物契約は、その満期が近付くと、満期前における先物契約に入れ替えられます。従って、例えば、8月に買い付けられ、保有されている先物契約が10月に満期となる場合があります。

時間が経過するにつれ、10月に満期を迎える先物契約は、11月限の先物契約に入れ替えられることになります。もっとも期近の先物契約とともに期先の先物契約との差額は、「乗換えに伴う収益(roll yield)」と呼ばれ、これは利益となることもあります。この先物契約にかかる市場が「その他の要因は考慮しないもの」とします。「逆輸送(バックワード・ディジョン: backwardation)」(期先の満期の先物契約の価格の方が期近の満期の先物契約の価格に比べて低いことを意味します。)である場合には、10月限先物契約の売却が、11月限先物契約よりも高い価格で行われ、「乗換えに伴う収益」が発生します。商品指數に含まれている先物契約の中には、過去に逆輸送の期間が持続することを示しているものもある一方で、逆輸送は常に存在している訳ではありません。

更に、商品指數に反映されている一定の商品には、過去に、「順輸送(コンタング: contango)」市場で取引されてきたものもあります。順輸送市場とは、先物契約の価格が期近限月のものよりも、期先限月のものの方が高くなっている市場のことです。特定の商品市場において逆輸送が存在しないことの結果として、「乗換えに伴う収益」がマイナスとなり得ます。このため、商品指數及び単一商品指數の価値に悪影響が及び、その結果として、マイクロ上場投資信託、商品上場投資信託及び商品指數上場投資信託の価値が下落するおそれがあります。更に、これにより、商品指數における期近先物契約及び次期近先物契約はブルームバーグ商品3ヶ月先物指數において用いられているものは異なるため、先物曲線の関連する部分が異なる量の逆輸送又は順輸送を示している場合、両指數に異なる形で影響を及ぼす逆輸送及び/又は順輸送がもたらされる可能性があります。しかし、特定の商品市場において順輸送(又は逆輸送)が存在することによって、自動的に「乗換えに伴う収益」がマイナスとなる(又はプラスとなる)ということではありません。潜在的な乗換えに伴う収益が実際に実現するかどうかは、先物曲線の形状に依存しています。「先物曲線」とは、異なる満期を有する先物契約に関して、先物契約の価格間の相関関係をグラフで表したものをおいいます。商品先物曲線の関連する部分が逆輸送となっている(右下がりの先物曲線となっている)場合には、その他の要因が全て同じであるとすれば、相対的に低くなっている先物価格が相対的に高くなっているスポット価格に収束していくに従って、関連する指標は上昇する傾向があります。順輸送の場合には、反対の結果が生じます。

以上

[掲載番号6]

令和4年9月7日

各 位

外国投資法人名 代表者 管理会社名 (銘柄コード 1689)	ウイズダムツリー・コモディティ・セキュリティーズ・リミテッド クリストファー・フォールズ ウイズダムツリー・マネジメント・ジャージー・リミテッド
代表者 問合せ先 担当者	スティーブン・ロス TMI総合法律事務所 中川秀宣 (TEL 03-6438-5660)

WisdomTree 天然ガス上場投資信託(ガスETF)に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの口数(令和4年9月7日午前0時(ロンドン時間2022年9月6日午後4時)現在)

2,914,661,138 口

2. 上場ETFの資産総額(令和4年9月7日午前0時(ロンドン時間2022年9月6日午後4時)現在)

(上場ETFの資産総額は、上場ETFの口数に上場ETFの一口あたりの資産額を乗じて計算しています。日本円への換算は、令和4年9月7日午前6時(ニューヨーク時間2022年9月6日午後5時)現在のブルームバーグによる為替レート(1米ドル=142.79円)により計算しています。)

14,085,430,233 円 (98,644,374.49 米ドル)

3. 上場ETFの一口あたりの資産額(令和4年9月7日午前0時(ロンドン時間2022年9月6日午後4時)現在)

(上場ETF一口当たりの資産額は、ロンドンの当日午後4時にロンドン証券取引所での取引が終了した後、指数が追隨する米国先物市場終了後に確定される指標の値を用いて、ロンドン時間同日午後4時現在のものとして計算されています。日本円への換算は、令和4年9月7日午前6時(ニューヨーク時間2022年9月6日午後5時)現在のブルームバーグによる為替レート(1米ドル=142.79円)により計算しています。)

4.833 円 (0.03 米ドル)

4. 上場ETFの一口あたりの資産額の日々の価格の変動幅と特定の指標の終値の日々の変動幅の乖離率(令和4年9月7日午前0時(ロンドン時間2022年9月6日午後4時)現在)

0.01%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left[\frac{\text{上場ETFの} \quad \text{特定の指標の}}{\text{一口あたりの資産額} \quad \text{終値}} - \frac{\text{前営業日の上場ETFの} \quad \text{前営業日の}}{\text{一口あたりの資産額} \quad \text{特定の指標の終値}} \right] \times 100 (\%)$$

5. ロールオーバー時の損益について

各々の単一商品指標は、特定の満期の先物契約から付けられますが、当該先物契約は、満期が近付くと、期先の先物契約に「乗り換える」必要が生じ、このプロセスは「乗換え(rolling)」と呼ばれます。単一商品指標を構成する取引所上場先物契約は、その満期が近付くと、満期前に期先の満期の同様の先物契約に入れ替えられます。従つて、例えば、8月に買付けられ、保有されている先物契約が10月に満期となる場合があります。

時間が経過するにつれ、10月に満期を迎える先物契約は、11月限の先物契約に入れ替えられることになります。もともと期近の先物契約とともに期先の先物契約との差額は、「乗換えに伴う収益(roll yield)」と呼ばれ、これは利益となることもあります。逆に損失となることもあります。この先物契約にかかる市場が「その他の要因は考慮しないもの」とします。「逆転(バックワードーション:backwardation)」(期先の満期の先物契約の価格の方が期近の満期の先物契約の価格に比べて低いことを意味します。)である場合には、10月限先物契約の売却が、11月限先物契約よりも高い価格で行われ、「乗換えに伴う収益」が発生します。商品指標に含まれている先物契約の中には、過去に逆転の期間が持続することを示しているものもある一方で、逆転は常に存在している訳ではありません。

更に、商品指標に反映されている一定の商品には、過去に、「順転(コンタング:contango)」市場で取引されてきたものもあります。順転市場とは、先物契約の価格が期近限月のものよりも、期先限月のものの方が高くなっている市場のことです。特定の商品市場において逆転が存在しないことの結果として、「乗換えに伴う収益」がマイナスとなります。このため、商品指標及び単一商品指標の価値に悪影響が及び、その結果として、マイクロ上場投資信託、单一マイクロ上場投資信託、商品上場投資信託及び商品指標上場投資信託の価値が下落するおそれがあります。更に、これにより、商品指標における期近先物契約及び次期近先物契約はブルームバーグ商品3ヶ月先物指標において用いられているものは異なるため、先物曲線の関連する部分が異なる量の逆転又は順転を示している場合、両指標に異なる形で影響を及ぼす逆転及び/又は順転がもたらされる可能性があります。しかし、特定の商品市場において順転(又は逆転)が存在することによって、自動的に「乗換えに伴う収益」がマイナスとなる(又はプラスとなる)ということではありません。潜在的な乗換えに伴う収益が実際に実現するかどうかは、先物曲線の形状に依存しています。「先物曲線」とは、異なる満期を有する先物契約に関し、先物契約の価格間の相関関係をグラフで表したものといいます。商品先物曲線の関連する部分が逆転となっている(右下がりの先物曲線となっている)場合には、その他の要因が全て同じであるとすれば、相対的に低くなっている先物価格が相対的に高くなっているスポット価格に収束していくに従って、関連する指標は上昇する傾向があります。順転の場合には、反対の結果が生じます。

以 上

[掲載番号7]

令和4年9月7日

各 位

外国投資法人名 代表者	ウイズダムツリー・コモディティ・セキュリティーズ・リミテッド クリストファー・フォールズ
管理会社名 (銘柄コード 1690) 代表者	ウイズダムツリー・マネジメント・ジャージー・リミテッド スティーブン・ロス
問合せ先 担当者	TMI総合法律事務所 中川秀宣 (TEL 03-6438-5660)

WisdomTree WTI 原油上場投資信託(原油ETF)に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの口数(令和4年9月7日午前0時(ロンドン時間2022年9月6日午後4時)現在)

76,625,770 口

2. 上場ETFの資産総額(令和4年9月7日午前0時(ロンドン時間2022年9月6日午後4時)現在)

(上場ETFの資産総額は、上場ETFの口数に上場ETFの一口あたりの資産額を乗じて計算しています。日本円への換算は、令和4年9月7日午前6時(ニューヨーク時間2022年9月6日午後5時)現在のブルームバーグによる為替レート(1米ドル=142.79円)により計算しています。)

103,857,410,371 円 (727,343,724.15 米ドル)

3. 上場ETFの一口あたりの資産額(令和4年9月7日午前0時(ロンドン時間2022年9月6日午後4時)現在)

(上場ETF一口当たりの資産額は、ロンドンの当日午後4時にロンドン証券取引所での取引が終了した後、指数が追随する米国先物市場終了後に確定される指標の値を用いて、ロンドン時間同日午後4時現在のものとして計算されています。日本円への換算は、令和4年9月7日午前6時(ニューヨーク時間2022年9月6日午後5時)現在のブルームバーグによる為替レート(1米ドル=142.79円)により計算しています。)

1,355 円 (9.49 米ドル)

4. 上場ETFの一口あたりの資産額の日々の価格の変動幅と特定の指標の終値の日々の変動幅の乖離率(令和4年9月7日午前0時(ロンドン時間2022年9月6日午後4時)現在)

0.01%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの} - \text{特定の指標の}}{\text{一口あたりの資産額} - \text{終値}} \right) \times 100 (\%)$$

$$\left(\frac{\text{前営業日の上場ETF} - \text{前営業日の}}{\text{一口あたりの資産額} - \text{特定の指標の終値}} \right) \times 100 (\%)$$

5. ロールオーバー時の損益について

各々の単一商品指數は、特定の満期の先物契約から償付されます。当該先物契約は、満期が近付くと、期先の先物契約に「乗り換える」必要が生じ、このプロセスは「乗換え(rolling)」と呼ばれます。単一商品指數を構成する取引所上場先物契約は、その満期が近付くと、満期前に期先の満期の同様の先物契約に入れ替えられます。従って、例えば、8月に買い付けられ、保有されている先物契約が11月に満期となる場合があります。もっとも期近の先物契約とともに期先の先物契約に入れ替えられることになります。もともと期近の先物契約とともに期先の先物契約に入れ替えられることもあります。

時間が経過するにつれ、10月に満期を迎える先物契約は、11月限の先物契約に入れ替えられることになります。この先物契約にかかる市場が(その他の要因は考慮しないものとします)、「逆輸送(バックワードーション:backwardation)」(期先の満期の先物契約の価格の方が期近の満期の先物契約の価格に比べて低いことを意味します)である場合には、10月限先物契約の売却が、11月限先物契約よりも高い価格で行われ、「乗換えに伴う収益」が発生します。商品指數に含まれている先物契約の中には、過去に逆輸送の期間が持続することを示しているものもある一方で、逆輸送は常に存在している訳ではありません。

更に、商品指數に反映されている一定の商品には、過去に、「順輸送(contango)」市場で取引されてきたものもあります。順輸送市場とは、先物契約の価格が期近限月のものよりも、期先限月のものの方が高くなっている市場のことです。特定の商品市場において逆輸送が存在しないことの結果として、「乗換えに伴う収益」がマイナスとなります。このため、商品指數及び単一商品指數の価値に悪影響が及び、その結果として、マイクロ上場投資信託、単一マイクロ上場投資信託、商品上場投資信託及び商品指數上場投資信託の価値が下落するおそれがあります。更に、これにより、商品指數における期近先物契約及び次期近先物契約はブルームバーグ商品3ヶ月先物指數において用いられているものは異なるため、先物曲線の関連する部分が異なる量の逆輸送又は順輸送を示している場合、両指數に異なる形で影響を及ぼす逆輸送及び又は順輸送がもたらされる可能性があります。しかし、特定の商品市場において順輸送(又は逆輸送)が存在することによって、自動的に「乗換えに伴う収益」がマイナスとなる(又はプラスとなる)ということではありません。潜在的な乗換えに伴う収益が実際に実現するかどうかは、先物曲線の形状に依存しています。「先物曲線」とは、異なる満期を有する先物契約に関し、先物契約の価格間の相関関係をグラフで表したものをおいいます。商品先物曲線の関連する部分が逆輸送となっている(右下がりの先物曲線となっている)場合には、その他の要因が全て同じであるとすれば、相対的に低くなっている先物価格が相対的に高くなっているスポット価格に収束していくに従って、関連する指標は上昇する傾向があります。順輸送の場合には、反対の結果が生じます。

以 上



[掲載番号8]

令和 4年 9月 7日

各 位

外国投資法人名 ウィズダムツリー・コモディティ・セキュリティーズ・リミテッド
代表者 クリストファー・フォールズ
管理会社名 ウィズダムツリー・マネジメント・ジャージー・リミテッド
(銘柄コード 1691)
代表者 スティーブン・ロス
問合せ先 TMI総合法律事務所
担当者 中川秀宣
(TEL 03-6438-5660)

WisdomTree ガソリン上場投資信託(ガソリンETF)に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの日数(令和4年9月7日午前0時(ロンドン時間2022年9月6日午後4時)現在)

206,311 曰

2. 上場ETFの資産総額（令和4年9月7日午前0時（ロンドン時間2022年9月6日午後4時）現在）

(上場ETFの資産総額は、上場ETFの口数に上場ETFの一口あたりの資産額を乗じて計算しています。日本円への換算は、令和4年9月7日午前6時(ニューヨーク時間2022年9月6日午後5時)現在のブルームバーグによる為替レート(1米ドル=142.79円)により計算しています。)

1,218,591,849 円 (8,534,154.00 米ドル)

3. 上場ETFの一口あたりの資産額(令和4年9月7日午前0時(ロンドン時間2022年9月6日午後4時)現在)

(上場ETF一口当たりの資産額は、ロンドンの当日午後4時にロンドン証券取引所での取引が終了した後、指数が追随する米国先物市場終了後に確定される指数の値を用いて、ロンドン時間同日午後4時現在のものとして計算されています。日本円への換算は、令和4年9月7日午前6時(ニューヨーク時間2022年9月6日午後5時)現在のブルームバーグによる為替レート(1米ドル=142.79円)により計算しています。)

5,907 円 (41.37 米ドル)

4. 上場ETFの一口あたりの資産額の日々の価格の変動幅と特定の指標の終値の日々の変動幅の乖離率(令和4年9月7日午前0時(ロンドン時間2022年9月6日午後4時)現在)

0.01%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの} - \text{特定の指標の}}{\text{一口あたりの資産額} - \text{終値}} \right) \times 100 (\%)$$

前営業日の上場ETFの
一口あたりの資産額

前営業日の
特定の指標の終値

5. ロールオーバー時の損益について

各々の単一商品指数は、特定の満期の先物契約から値付けされますが、当該先物契約は、満期が近付くと、期先の先物契約に「乗り換える」必要が生じ、このプロセスを「乗換え(rolling)」と呼ばれます。单一商品指値を構成する取引所上場先物契約は、その満期が近付くと、満期前に期先の満期の同様の先物契約に入れ替えられます。従って、例えば、8月に買付けられ、保有されている先物契約が10月に満期となる場合があります。

時間が経過につれ、10月に満期を迎える先物契約は、11月限の先物契約に入れ替えられることになります。もともと期近の先物契約とともに期先の先物契約との差額は、「換乗(Exercising)」と呼ばれ、これは利益となることもあります。この先物契約にかかる市場がその他の要因を考慮しないものとします。
レバゲート(Backwardation)」
「期先の満期の先物契約の価格の方が期近の満期の先物契約の価格に比べて低いことを意味します。
ある場合には、10月限先物契約の売却が、11月限先物契約よりも高い価格で行われ、「換乗に伴う収益」が発生します。商品指数に含まれている先物契約の中には、過去に逆戻の期間が持続することを示しているものもある一方で、逆戻は常に存在している訳ではありません。

更に、商品指指数に反映されている一定の商品には、過去に「順輸(カントン)」市場で取引されたものも含まれます。つまり、逆輸出で市に供給している物ではありません。

更に、商品指指数に反映されている一定の商品には、過去に「順輸(カントン):contango」市場で取引されたものも含まれます。順輸市場とは、先物契約の価格が期近月限のものよりも、期限先月限のものの方が高くなっている市場のことです。特定の商品市場において逆輸が存在しない結果として、「兼換えに伴う逆差」がマイナスになります。そのため、商品指指数及び單一商品指指数の価値に影響を与えることは、その結果として、マイクロ上場投資信託、單一マイクロ上場投資信託、商品上場投資信託及び商品指指数における期近先物契約及び期次期近先物契約はブルームバーグ商品指指数に用いているものは異なるため、先物曲線の関連する部分が異なる逆差又は順差を示している場合、両指標に異なる形で影響を及ぼす逆輸及び/又は順輸がもたらされる可能性があります。しかし、特定の商品市場において順輸(又は逆輸)が存在することによって、自動的に「兼換えに伴う逆差」がマイナスになる(マイナス)ということではありません。潜在的な兼換えに伴う逆差が実現するかどうかは、先物曲線の形状に依存しています。先物曲線とは、異なる満期を有する先物契約に一括して、先物契約の価格範囲の相間関係をグラフで表したものであります。先物曲線の関連する部分が逆並びになっている(右下から左の先物曲線とならない)場合には、その他の要因が完全同じであるとすれば、相対的に低くなっている先物價格が相対的に高くなっているスワップ価格に収束していく傾向があります。順輸の場合には、反対の結果が牛じます。

乙

[掲載番号9]

令和4年9月7日

各 位

外国投資法人名 代表者 管理会社名 (銘柄コード 1692)	ウイズダムツリー・コモディティ・セキュリティーズ・リミテッド クリストファー・フォールズ ウイズダムツリー・マネジメント・ジャージー・リミテッド
代表者 問合せ先 担当者	ステーブン・ロス TMI総合法律事務所 中川秀宣 (TEL 03-6438-5660)

WisdomTree アルミニウム上場投資信託(アルミETF)に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの口数(令和4年9月7日午前0時(ロンドン時間2022年9月6日午後4時)現在)

14,868,891 口

2. 上場ETFの資産総額(令和4年9月7日午前0時(ロンドン時間2022年9月6日午後4時)現在)

(上場ETFの資産総額は、上場ETFの口数に上場ETFの一口あたりの資産額を乗じて計算しています。日本円への換算は、令和4年9月7日午前6時(ニューヨーク時間2022年9月6日午後5時)現在のブルームバーグによる為替レート(1米ドル=142.79円)により計算しています。)

6,633,623,611 円 (46,457,200.16 米ドル)

3. 上場ETFの一口あたりの資産額(令和4年9月7日午前0時(ロンドン時間2022年9月6日午後4時)現在)

(上場ETF一口当たりの資産額は、ロンドンの当日午後4時にロンドン証券取引所での取引が終了した後、指数が追隨する米国先物市場終了後に確定される指標の値を用いて、ロンドン時間同日午後4時現在のものとして計算されています。日本円への換算は、令和4年9月7日午前6時(ニューヨーク時間2022年9月6日午後5時)現在のブルームバーグによる為替レート(1米ドル=142.79円)により計算しています。)

446 円 (3.12 米ドル)

4. 上場ETFの一口あたりの資産額の日々の価格の変動幅と特定の指標の終値の日々の変動幅の乖離率(令和4年9月7日午前0時(ロンドン時間2022年9月6日午後4時)現在)

0.01%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left[\frac{\text{上場ETFの} \quad \text{特定の指標の} \quad}{\text{一口あたりの資産額} \quad \text{終値}} - \frac{\text{前営業日の上場ETFの} \quad \text{前営業日の} \quad}{\text{一口あたりの資産額} \quad \text{特定の指標の終値}} \right] \times 100 (\%)$$

5. ロールオーバー時の損益について

各々の単一商品指標は、特定の満期の先物契約から値付けされますが、当該先物契約は満期が近づくと期先の先物契約に「乗り換える」必要が生じ、このプロセスは「乗換え(Rolling)」と呼ばれます。単一商品指標を構成する取引所上場先物契約は、その満期が近づくと、満期前に期先の満期の同様の先物契約に入れ替えられます。従って、例えば、8月に買い付けられ、保有されている先物契約が10月に満期となる場合があります。

時間が経過するにつれ、10月に満期を迎える先物契約は、11月限の先物契約に入れ替えられることになります。もっとも期近の先物契約とともに期先の先物契約との差額は、「乗換えに伴う収益(roll yield)」と呼ばれ、これは利益となることもあります。この先物契約にかかる市場が「その他の要因は考慮しないもの」とします。「逆輸送(ハンクワーディション:backwardation)」(期先の満期の先物契約の価格の方が期近の満期の先物契約の価格に比べて低いことを意味します。)である場合には、10月限先物契約の売却が、11月限先物契約よりも高い価格で行われ、「乗換えに伴う収益」が発生します。商品指標に含まれている先物契約の中には、過去に逆輸送の期間が持続することを示しているものもある一方で、逆輸送は常に存在している訳ではありません。

更に、商品指標に反映されている一定の商品には、過去に、「順輸送(contango)」市場で取引されてきたものもあります。順輸送市場とは、先物契約の価格が期近限月のものよりも、期先限月のものの方が高くなっている市場のことです。特定の商品市場において逆輸送が存在しないことの結果として、「乗換えに伴う収益」がマイナスとなり得ます。このため、商品指標及び単一商品指標の価値に悪影響が及び、その結果として、マイクロ上場投資信託、商品上場投資信託及び商品指標上場投資信託の価値が下落するおそれがあります。更に、これにより、商品指標における期近先物契約及び次期近先物契約はブルームバーグ商品3ヶ月先物指標において用いられているものは異なるため、先物曲線の関連する部分が異なる量の逆輸送又は順輸送を示している場合、両指標に異なる形で影響を及ぼす逆輸送及び/又は順輸送がもたらされる可能性があります。しかし、特定の商品市場において順輸送(又は逆輸送)が存在することによって、自動的に「乗換えに伴う収益」がマイナスとなる(又はプラスとなる)ということではありません。潜在的な乗換えに伴う収益が実際に実現するかどうかは、先物曲線の形状に依存しています。「先物曲線」とは、異なる満期を有する先物契約に関し、先物契約の価格間の相関関係をグラフで表したものといいます。商品先物曲線の関連する部分が逆輸送となっている(右下がりの先物曲線となっている)場合には、その他の要因が全て同じであるとすれば、相対的に低くなっている先物価格が相対的に高くなっているスポット価格に収束していくに従って、関連する指標は上昇する傾向があります。順輸送の場合には、反対の結果が生じます。

以 上

[掲載番号10]

令和4年9月7日

各 位

外国投資法人名 代表者 管理会社名 (銘柄コード 1693)	イズダムツリー・コモディティ・セキュリティーズ・リミテッド クリストファー・フォールズ イズダムツリー・マネジメント・ジャージー・リミテッド
代表者 問合せ先 担当者	スティーブン・ロス TMI総合法律事務所 中川秀宣 (TEL 03-6438-5660)

WisdomTree 銅上場投資信託(銅ETF)に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの口数(令和4年9月7日午前0時(ロンドン時間2022年9月6日午後4時)現在)

12,236,055 口

2. 上場ETFの資産総額(令和4年9月7日午前0時(ロンドン時間2022年9月6日午後4時)現在)

(上場ETFの資産総額は、上場ETFの口数に上場ETFの一口あたりの資産額を乗じて計算しています。日本円への換算は、令和4年9月7日午前6時(ニューヨーク時間2022年9月6日午後5時)現在のブルームバーグによる為替レート(1米ドル=142.79円)により計算しています。)

52,945,973,585 円 (370,796,089.26 米ドル)

3. 上場ETFの一口あたりの資産額(令和4年9月7日午前0時(ロンドン時間2022年9月6日午後4時)現在)

(上場ETF一口当たりの資産額は、ロンドンの当日午後4時にロンドン証券取引所での取引が終了した後、指数が追隨する米国先物市場終了後に確定される指標の値を用いて、ロンドン時間同日午後4時現在のものとして計算されています。日本円への換算は、令和4年9月7日午前6時(ニューヨーク時間2022年9月6日午後5時)現在のブルームバーグによる為替レート(1米ドル=142.79円)により計算しています。)

4,327 円 (30.30 米ドル)

4. 上場ETFの一口あたりの資産額の日々の価格の変動幅と特定の指標の終値の日々の変動幅の乖離率(令和4年9月7日午前0時(ロンドン時間2022年9月6日午後4時)現在)

0.01%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left[\frac{\text{上場ETFの} \quad \text{特定の指標の} \\ \text{一口あたりの資産額} \quad \text{終値} \\ \text{前営業日の上場ETFの} \quad \text{前営業日の} \\ \text{一口あたりの資産額} \quad \text{特定の指標の終値}}{\text{前営業日の上場ETFの} \quad \text{前営業日の} \\ \text{一口あたりの資産額} \quad \text{特定の指標の終値}} \right] \times 100 (\%)$$

5. ロールオーバー時の損益について

各々の単一商品指標は、特定の満期の先物契約から値付けされますが、当該先物契約は、満期が近付くと、期先の先物契約に「乗り換える」必要が生じ、このプロセスは「乗換え(rolling)」と呼ばれます。単一商品指標を構成する取引所上場先物契約は、その満期が近付くと、満期前に期先の満期の同様の先物契約に入れ替えられます。従って、例えば、8月に買い付けられ、保有されている先物契約が10月に満期となる場合があります。

時間が経過するにつれ、10月に満期を迎える先物契約は、11月限の先物契約に入れ替えられることになります。もっとも期近の先物契約とともに期先の先物契約との差額は、「乗換えに伴う収益(roll yield)」と呼ばれ、これは利益となることもあります。この先物契約にかかる市場が(その他の要因は考慮しないものとします。)「逆輸送(バックワードエフェクト:backwardation)」(期先の満期の先物契約の方が期近の満期の先物契約の価格に比べて低いことを意味します。)である場合には、10月限先物契約の売却が、11月限先物契約よりも高い価格で行われ、「乗換えに伴う収益」が発生します。商品指標に含まれている先物契約の中には、過去に逆輸送の期間が持続することを示しているものもある一方で、逆輸送は常に存在している訳ではありません。

更に、商品指標に反映されている一定の商品には、過去に、「順輸送(contango)」市場で取引されてきたものもあります。順輸送市場とは、先物契約の価格が期近限月のものよりも、期先限月のものが高くなっている市場のことです。特定の商品市場において逆輸送が存在しないとの結果として、「乗換えに伴う収益」がマイナスとなり得ます。このため、商品指標及び単一商品指標の価値に悪影響が及び、その結果として、マイクロ上場投資信託、単一マイクロ上場投資信託、商品上場投資信託及び商品指標上場投資信託の価値が下落するおそれがあります。更に、これにより、商品指標における期近先物契約及び次期近先物契約はブルームバーグ商品3ヶ月先物指標において用いられているものは異なるため、先物曲線の関連する部分が異なる量の逆輸送又は順輸送を示している場合、両指標に異なる形で影響を及ぼす逆輸送及び/又は順輸送がもたらされる可能性があります。しかし、特定の商品市場において順輸送(又は逆輸送)が存在することによって、自動的に「乗換えに伴う収益」がマイナスとなる(又はプラスとなる)ということではありません。潜在的な乗換えに伴う収益が実際に実現するかどうかは、先物曲線の形状に依存しています。「先物曲線」とは、異なる満期を有する先物契約に関し、先物契約の価格間の相関関係をグラフで表したものといいます。商品先物曲線の関連する部分が逆輸送となっている(右下がりの先物曲線となっている)場合には、その他の要因が全て同じであるとすれば、相対的に低くなっている先物価格が相対的に高くなっているスポット価格に収束していくに従って、関連する指標は上昇する傾向があります。順輸送の場合には、反対の結果が生じます。

以 上

[掲載番号11]

令和4年9月7日

各 位

外国投資法人名 代表者 管理会社名 (銘柄コード 1694)	ウイズダムツリー・コモディティ・セキュリティーズ・リミテッド クリストファー・フォールズ ウイズダムツリー・マネジメント・ジャージー・リミテッド
問合せ先 担当者	スティーブン・ロス TMI総合法律事務所 中川秀宣 (TEL 03-6438-5660)

WisdomTree ニッケル上場投資信託(ニッケルETF)に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの口数(令和4年9月7日午前0時(ロンドン時間2022年9月6日午後4時)現在)

6,905,987 口

2. 上場ETFの資産総額(令和4年9月7日午前0時(ロンドン時間2022年9月6日午後4時)現在)

(上場ETFの資産総額は、上場ETFの口数に上場ETFの一口あたりの資産額を乗じて計算しています。日本円への換算は、令和4年9月7日午前6時(ニューヨーク時間2022年9月6日午後5時)現在のブルームバーグによる為替レート(1米ドル=142.79円)により計算しています。)

19,859,362,610 円 (139,080,906.29 米ドル)

3. 上場ETFの一口あたりの資産額(令和4年9月7日午前0時(ロンドン時間2022年9月6日午後4時)現在)

(上場ETF一口当たりの資産額は、ロンドンの当日午後4時にロンドン証券取引所での取引が終了した後、指数が追隨する米国先物市場終了後に確定される指標の値を用いて、ロンドン時間同日午後4時現在のものとして計算されています。日本円への換算は、令和4年9月7日午前6時(ニューヨーク時間2022年9月6日午後5時)現在のブルームバーグによる為替レート(1米ドル=142.79円)により計算しています。)

2,876 円 (20.14 米ドル)4. 上場ETFの一口あたりの資産額の日々の価格の変動幅と特定の指標の終値の日々の変動幅の乖離率
(令和4年9月7日午前0時(ロンドン時間2022年9月6日午後4時)現在)0.01%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left[\frac{\text{上場ETFの} \\ \text{一口あたりの資産額} \\ - \text{前営業日の上場ETFの} \\ \text{一口あたりの資産額}}{\text{特定の指標の} \\ \text{終値} \\ - \text{前営業日の} \\ \text{特定の指標の終値}} \right] \times 100 (\%)$$

5. ロールオーバー時の損益について

各々の単一商品指標は、特定の満期の先物契約から償付けされますが、当該先物契約は満期が近付くと期先の先物契約に「乗り換える」必要が生じ、このプロセスは「乗換え(rolling)」と呼ばれます。単一商品指標を構成する取引所上場先物契約は、その満期が近付くと、満期前に期先の満期の同様の先物契約に入れ替えられます。従って、例えば、8月に買い付けられ、保有されている先物契約が10月に満期となる場合があります。

時間が経過するにつれ、10月に満期を迎える先物契約は、11月限の先物契約に入れ替えられることになります。もっとも期近の先物契約とともに期先の先物契約との差額は、「乗換えに伴う収益(roll yield)」と呼ばれ、これは利益となることもあります。この先物契約にかかる市場が「その他の要因は考慮しないもの」とします。「逆輸送(バックワードーション:backwardation)」(期先の満期の先物契約の価格の方が期近の満期の先物契約の価格に比べて低いことを意味します。)である場合には、10月限先物契約の売却が、11月限先物契約よりも高い価格で行われ、「乗換えに伴う収益」が発生します。商品指標に含まれている先物契約の中には、過去に逆輸送の期間が持続することを示しているものもある一方で、逆輸送は常に存在している訳ではありません。

更に、商品指標に反映されている一定の商品には、過去に、「順輸送(contango)」市場で取引されてきたものもあります。順輸送市場とは、先物契約の価格が期近限月のものよりも、期先限月のものの方が高くなっている市場のことです。特定の商品市場において逆輸送が存在しないことの結果として、「乗換えに伴う収益」がマイナスとなり得ます。このため、商品指標及び単一商品指標の価値に悪影響が及び、その結果として、マイクロ上場投資信託、商品上場投資信託及び商品指標上場投資信託の価値が下落するおそれがあります。更に、これにより、商品指標における期近先物契約及び次期近先物契約はブルームバーグ商品3ヶ月先物指標において用いられているものとは異なるため、先物曲線の関連する部分が異なる量の逆輸送又は順輸送を示している場合、両指標に異なる形で影響を及ぼす逆輸送及び/又は順輸送がもたらされる可能性があります。しかし、特定の商品市場において順輸送(又は逆輸送)が存在することによって、自動的に「乗換えに伴う収益」がマイナスとなる(又はプラスとなる)ということではありません。潜在的な乗換えに伴う収益が実際に実現するかどうかは、先物曲線の形状に依存しています。「先物曲線」とは、異なる満期を有する先物契約に関し、先物契約の価格間の相関関係をグラフで表したものをおいいます。商品先物曲線の関連する部分が逆輸送となっている(右下がりの先物曲線となっている)場合には、その他の要因が全て同じであるとすれば、相対的に低くなっている先物価格が相対的に高くなっているスポット価格に収束していくに従って、関連する指標は上昇する傾向があります。順輸送の場合には、反対の結果が生じます。

以 上

[掲載番号12]

令和4年9月7日

各 位

外国投資法人名	ウイズダムツリー・コモディティ・セキュリティーズ・リミテッド
代表者	クリストファー・フォールズ
管理会社名 (銘柄コード 1695)	ウイズダムツリー・マネジメント・ジャージー・リミテッド
代表者	スティーブン・ロス
問合せ先 担当者	TMI総合法律事務所 中川秀宣 (TEL 03-6438-5660)

WisdomTree 小麦上場投資信託(小麦ETF)に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの口数(令和4年9月7日午前0時(ロンドン時間2022年9月6日午後4時)現在)

149,828,099 口

2. 上場ETFの資産総額(令和4年9月7日午前0時(ロンドン時間2022年9月6日午後4時)現在)

(上場ETFの資産総額は、上場ETFの口数に上場ETFの一口あたりの資産額を乗じて計算しています。日本円への換算は、令和4年9月7日午前6時(ニューヨーク時間2022年9月6日午後5時)現在のブルームバーグによる為替レート(1米ドル=142.79円)により計算しています。)

17,528,156,577 円 (122,754,790.79 米ドル)

3. 上場ETFの一口あたりの資産額(令和4年9月7日午前0時(ロンドン時間2022年9月6日午後4時)現在)

(上場ETF一口当たりの資産額は、ロンドンの当日午後4時にロンドン証券取引所での取引が終了した後、指数が追随する米国先物市場終了後に確定される指標の値を用いて、ロンドン時間同日午後4時現在のものとして計算されています。日本円への換算は、令和4年9月7日午前6時(ニューヨーク時間2022年9月6日午後5時)現在のブルームバーグによる為替レート(1米ドル=142.79円)により計算しています。)

117 円 (0.82 米ドル)

4. 上場ETFの一口あたりの資産額の日々の価格の変動幅と特定の指標の終値の日々の変動幅の乖離率(令和4年9月7日午前0時(ロンドン時間2022年9月6日午後4時)現在)

0.01%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの} - \text{特定の指標の}}{\text{一口あたりの資産額} - \text{終値}} - \frac{\text{前営業日の上場ETFの} - \text{前営業日の}}{\text{一口あたりの資産額} - \text{終値}} \right) \times 100 (\%)$$

5. ロールオーバー時の損益について

各々の単一商品指標は、特定の満期の先物契約から値付けされますが、当該先物契約は、満期が近付くと、期先の先物契約に「乗換える」必要が生じ、このプロセスは「乗換え(rolling)」と呼ばれます。単一商品指標を構成する取引所上場先物契約は、その満期が近付くと、満期前に期先の満期の同様の先物契約に入れ替えられます。従って、例えば、8月に買い付けられ、保有されている先物契約が10月に満期となる場合があります。

時間が経過するにつれ、10月に満期を迎える先物契約は、11月限の先物契約に入れ替えられます。もっとも期近の先物契約とともに期先の先物契約との差額は、「乗換えに伴う収益(roll yield)」と呼ばれ、これは利益となることもあります。もっとも期近の先物契約とともに期先の先物契約との差額は、「逆戻(バックワード・ディジョン:backwardation)」(期先の満期の先物契約の価格の方が期近の満期の先物契約の価格に比べて低いことを意味します。)である場合には、10月限先物契約の売却が、11月限先物契約よりも高い価格で行われ、「乗換えに伴う収益」が発生します。商品指標に含まれている先物契約の中には、過去に逆戻の期間が持続することを示しているものもある一方で、逆戻は常に存在している訳ではありません。

更に、商品指標に反映されている一定の商品には、過去に、「順翰(コンタング:contango)」市場で取引されてきたものがあります。順翰市場とは、先物契約の価格が期近限月のものよりも、期先限月のものの方が高くなっている市場のことです。特定の商品市場において逆戻が存在しないことの結果として、「乗換えに伴う収益」がマイナスになります。このため、商品指標及び単一商品指標の価値に悪影響が及び、その結果として、マイクロ上場投資信託、商品上場投資信託及び商品指標上場投資信託の価値が下落するおそれがあります。更に、これにより、商品指標における期先物契約及び次期近先物契約はブルームバーグ商品3ヶ月先物指標において用いられているものとは異なるため、先物曲線の関連する部分が異なる量の逆戻又は順翰を示している場合、両指標に異なる形で影響を及ぼす逆戻及び/又は順翰がもたらされる可能性があります。しかし、特定の商品市場において順翰(又は逆戻)が存在することによって、自動的に「乗換えに伴う収益」がマイナスとなる(又はプラスとなる)ということではありません。潜在的な乗換えに伴う収益が実際に実現するかどうかは、先物曲線の形状に依存しています。「先物曲線」とは、異なる満期を有する先物契約に関し、先物契約の価格間の相関関係をグラフで表したものといいます。商品先物曲線の関連する部分が逆戻となっている(右下がりの先物曲線となっている)場合には、その他の要因が全て同じであるとすれば、相対的に低くなっている先物価格が相対的に高くなっているスポット価格に収束していくに従って、関連する指標は上昇する傾向があります。順翰の場合には、反対の結果が生じます。

以 上

[掲載番号13]

令和4年9月7日

各 位

外国投資法人名	ウイズダムツリー・コモディティ・セキュリティーズ・リミテッド
代表者	クリストファー・フォールズ
管理会社名 (銘柄コード 1696)	ウイズダムツリー・マネジメント・ジャージー・リミテッド
代表者	スティーブン・ロス
問合せ先 担当者	TMI総合法律事務所 中川秀宣 (TEL 03-6438-5660)

WisdomTree とうもろこし上場投資信託(コーンETF)に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの口数(令和4年9月7日午前0時(ロンドン時間2022年9月6日午後4時)現在)

28,412,747 口

2. 上場ETFの資産総額(令和4年9月7日午前0時(ロンドン時間2022年9月6日午後4時)現在)

(上場ETFの資産総額は、上場ETFの口数に上場ETFの一口あたりの資産額を乗じて計算しています。日本円への換算は、令和4年9月7日午前6時(ニューヨーク時間2022年9月6日午後5時)現在のブルームバーグによる為替レート(1米ドル=142.79円)により計算しています。)

5,450,099,519 円 (38,168,635.89 米ドル)

3. 上場ETFの一口あたりの資産額(令和4年9月7日午前0時(ロンドン時間2022年9月6日午後4時)現在)

(上場ETF一口当たりの資産額は、ロンドンの当日午後4時にロンドン証券取引所での取引が終了した後、指数が追随する米国先物市場終了後に確定される指標の値を用いて、ロンドン時間同日午後4時現在のものとして計算されています。日本円への換算は、令和4年9月7日午前6時(ニューヨーク時間2022年9月6日午後5時)現在のブルームバーグによる為替レート(1米ドル=142.79円)により計算しています。)

192 円 (1.34 米ドル)

4. 上場ETFの一口あたりの資産額の日々の価格の変動幅と特定の指標の終値の日々の変動幅の乖離率(令和4年9月7日午前0時(ロンドン時間2022年9月6日午後4時)現在)

0.01%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{上場ETFの} \quad \text{特定の指標の} \\ \text{一口あたりの資産額} \quad \text{終値}}{\text{前営業日の上場ETFの} \quad \text{前営業日の} \\ \text{一口あたりの資産額} \quad \text{特定の指標の終値}} - 1 \right) \times 100 (\%)$$

5. ロールオーバー時の損益について

各々の単一商品指數は、特定の満期の先物契約から償付けされますが、当該先物契約は、満期が近付くと、期先の先物契約に「乗り換える」必要が生じ、このプロセスは「乗換え(rolling)」と呼ばれます。単一商品指數を構成する取引所上場先物契約は、その満期が近付くと、満期前に期先の満期の同様の先物契約に入れ替えられます。従って、例えば、8月に買い付けられ、保有されている先物契約が10月に満期となる場合があります。

時間が経過するにつれ、10月に満期を迎える先物契約は、11月限の先物契約に入れ替えられることになります。もっとも期近の先物契約とともに期先の先物契約との差額は、「乗換えに伴う収益(roll yield)」と呼ばれ、これは利益となることもあります。この先物契約にかかる市場が(その他の要因は考慮しないものとします)、「逆輸入(バックワード・ディジョン:backwardation)」(期先の満期の先物契約の方が期近の満期の先物契約の価格に比べて低いことを意味します。)である場合には、10月限先物契約の売却が、11月限先物契約よりも高い価格で行われ、「乗換えに伴う収益」が発生します。商品指數に含まれている先物契約の中には、過去に逆輸入の期間が持続することを示しているものもある一方で、逆輸入は常に存在している訳ではありません。

更に、商品指數に反映されている一定の商品には、過去に、「順輸出(コンタング:contango)」市場で取引されてきたものもあります。順輸出市場とは、先物契約の価格が期近限月のものよりも、期先限月のものの方が高くなっている市場のことです。特定の商品市場において逆輸入が存在しないことの結果として、「乗換えに伴う収益」がマイナスとなります。このため、商品指數及び単一商品指數の価値に悪影響が及び、その結果として、マイクロ上場投資信託、單一マイクロ上場投資信託、商品上場投資信託及び商品指數上場投資信託の価値が下落するおそれがあります。更に、これにより、商品指數における期近先物契約及び次期近先物契約はブルームバーグ商品3ヶ月先物指數において用いられているものは異なるため、先物曲線の関連する部分が異なる量の逆輸入又は順輸出を示している場合、両指數に異なる形で影響を及ぼす逆輸入及び順輸出がもたらされる可能性があります。しかし、特定の商品市場において順輸出(又は逆輸入)が存在することによって、自動的に「乗換えに伴う収益」がマイナスとなる(又はプラスとなる)ということではありません。潜在的な乗換えに伴う収益が実際に実現するかどうかは、先物曲線の形状に依存しています。「先物曲線」とは、異なる満期を有する先物契約に関し、先物契約の価格間の相関関係をグラフで表したものといいます。商品先物曲線の関連する部分が逆輸入となっている(右下がりの先物曲線となっている)場合には、その他の要因が全て同じであるとすれば、相対的に低くなっている先物価格が相対的に高くなっているスポット価格に収束していくに従って、関連する指數は上昇する傾向があります。順輸の場合には、反対の結果が生じます。

以上

[掲載番号14]

令和4年9月7日

各 位

外国投資法人名	ウイズダムツリー・コモディティ・セキュリティーズ・リミテッド
代表者	クリストファー・フォールズ
管理会社名	ウイズダムツリー・マネジメント・ジャージー・リミテッド
(銘柄コード 1697)	
代表者	スティーブン・ロス
問合せ先	TMI総合法律事務所
担当者	中川秀宣 (TEL 03-6438-5660)

WisdomTree 大豆上場投資信託(大豆ETF)に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの口数(令和4年9月7日午前0時(ロンドン時間2022年9月6日午後4時)現在)

612,019 口

2. 上場ETFの資産総額(令和4年9月7日午前0時(ロンドン時間2022年9月6日午後4時)現在)

(上場ETFの資産総額は、上場ETFの口数に上場ETFの一口あたりの資産額を乗じて計算しています。日本円への換算は、令和4年9月7日午前6時(ニューヨーク時間2022年9月6日午後5時)現在のブルームバーグによる為替レート(1米ドル=142.79円)により計算しています。)

2,490,493,593 円 (17,441,652.73 米ドル)

3. 上場ETFの一口あたりの資産額(令和4年9月7日午前0時(ロンドン時間2022年9月6日午後4時)現在)

(上場ETF一口当たりの資産額は、ロンドンの当日午後4時にロンドン証券取引所での取引が終了した後、指数が追隨する米国先物市場終了後に確定される指標の値を用いて、ロンドン時間同日午後4時現在のものとして計算されています。日本円への換算は、令和4年9月7日午前6時(ニューヨーク時間2022年9月6日午後5時)現在のブルームバーグによる為替レート(1米ドル=142.79円)により計算しています。)

4,069 円 (28.50 米ドル)

4. 上場ETFの一口あたりの資産額の日々の価格の変動幅と特定の指標の終値の日々の変動幅の乖離率(令和4年9月7日午前0時(ロンドン時間2022年9月6日午後4時)現在)

0.01%

(参考) 乖離率の計算式

$$\left[\frac{\text{上場ETFの} \\ \text{一口あたりの資産額}}{\text{前営業日の上場ETFの} \\ \text{一口あたりの資産額}} - \frac{\text{特定の指標の} \\ \text{終値}}{\text{前営業日の} \\ \text{特定の指標の終値}} \right] \times 100 (\%)$$

5. ロールオーバー時の損益について

各々の単一商品指數は、特定の満期の先物契約から償付けされますが、当該先物契約は、満期が近付くと、期先の先物契約に「乗り換える」必要が生じ、このプロセスは「乗換え(rolling)」と呼ばれます。単一商品指數を構成する取引所上場先物契約は、その満期が近付くと、満期前に期先の満期の同様の先物契約に入れ替えられます。従って、例えば、8月に買い付けられ、保有されている先物契約が10月に満期となる場合があります。もっとも期近の先物契約とともに期先の先物契約に入れ替わることになります。もっとも期近の先物契約とともに期先の先物契約に入れ替わることになります。この先物契約にかかる市場が「その他の要因は考慮しないもの」とします。「逆輸送(バックワード・ショック: backwardation)」(期先の満期の先物契約の方が期近の満期の先物契約の価格に比べて低いことを意味します。)である場合には、10月限先物契約の売却が、11月限先物契約よりも高い価格で行われ、「乗換えに伴う収益」が発生します。商品指數に含まれている先物契約の中には、過去に逆輸送の期間が持続することを示しているものもある一方で、逆輸送は常に存在している訳ではありません。

更に、商品指數に反映されている一定の商品には、過去に、「順輸送(コンタング: contango)」市場で取引されてきたものもあります。順輸送市場とは、先物契約の価格が期近限月のものよりも、期先限月のものの方が高くなっている市場のことです。特定の商品市場において逆輸送が存在しないことの結果として、「乗換えに伴う収益」がマイナスとなり得ます。このため、商品指數及び単一商品指數の価値に悪影響が及び、その結果として、マイクロ上場投資信託、單一マイクロ上場投資信託、商品上場投資信託及び商品指數上場投資信託の価値が下落するおそれがあります。更に、これにより、商品指數における期近先物契約及び次期近先物契約はブルームバーグ商品3ヶ月先物指數において用いられているものは異なるため、先物曲線の関連する部分が異なる量の逆輸送又は順輸送を示している場合、両指數に異なる形で影響を及ぼす逆輸送及び/又は順輸送がもたらされる可能性があります。しかし、特定の商品市場において順輸送(又は逆輸送)が存在することによって、自動的に「乗換えに伴う収益」がマイナスとなる(又はプラスとなる)ということではありません。潜在的な乗換えに伴う収益が実際に実現するかどうかは、先物曲線の形状に依存しています。「先物曲線」とは、異なる満期を有する先物契約に関して、先物契約の価格間の相関関係をグラフで表したものといいます。商品先物曲線の関連する部分が逆輸送となっている(右下がりの先物曲線となっている)場合には、その他の要因が全て同じであるとすれば、相対的に低くなっている先物価格が相対的に高くなっているスポット価格に収束していくに従って、関連する指標は上昇する傾向があります。順輸送の場合には、反対の結果が生じます。

以上